

Спецификация форматов отчетов Клирингового центра, предоставляемых Участникам срочного рынка

I.	Отчет о заключенных Фьючерсах.....	70
II.	Отчет о заключенных Опционах.....	71
III.	Отчет об итогах Торгов Фьючерсами.....	72
IV.	Отчет об итогах Торгов Опционами.....	74
V.	Отчет об обязательствах по Фьючерсам.....	75
VI.	Отчет об обязательствах по Опционам.....	75
VII.	Отчет об обязательствах по перечислению денежных средств.....	76

Отчеты предоставляются в виде файлов формата FoxPro 2.x.

В имени файлов ХХ означает код Участника срочного рынка, УУ – код Группы объединенных разделов.

I. Отчет о заключенных Фьючерсах

Имя файла - f04_XXYY.dbf

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(10)	Идентификационный номер записи Реестра сделок
isin	char(25)	Код (обозначение) Фьючерса
price	numeric(16,5)	Цена Фьючерса (в пунктах)
vol	numeric(10)	Количество заключенных Фьючерсов (в штуках)
kod_sell	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Продавцом
kod_buy	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Покупателем
date	char(10)	Дата регистрации Фьючерсов (в формате YYYY/MM/DD)
time	char(8)	Время регистрации Фьючерсов
profit_usd	numeric(20,4)	Не используется
type	numeric(1)	Признак: 0 – Фьючерсы, заключенные на основании безадресной Заявки, 1 – Фьючерсы, обязательства по которым возникли в результате исполнения Опционов, 2 – Фьючерсы, заключенные на основании адресной Заявки, 3 - Фьючерсы, обязательства по которым возникли в ходе проведения процедуры принудительного закрытия позиций.
var_marg_b	numeric(16,2)	Обязательства Покупателя по уплате Вариационной маржи по Фьючерсам (в тенге)
var_marg_s	numeric(16,2)	Обязательства Продавца по уплате Вариационной маржи по Фьючерсам (в тенге)
user_sell	char(20)	Имя Продавца
user_buy	char(20)	Имя Покупателя
no_buy	numeric(10)	Идентификационный номер Заявки, поданной Покупателем, на основании которой заключены Фьючерсы
no_sell	numeric(10)	Идентификационный номер Заявки, поданной Продавцом, на основании которой заключены Фьючерсы
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в тенге)
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в тенге)
date2	date	Дата регистрации Фьючерсов

comm_buy	char(20)	Комментарий в Заявке, поданной Покупателем
comm_sell	char(20)	Комментарий в Заявке, поданной Продавцом
du_buy	numeric(1)	Всегда 0
du_sell	numeric(1)	Всегда 0
fee_ns_b	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Фьючерсы, заключенные на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Покупателем (в тенге)
fee_ns_s	numeric(16, 2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Фьючерсы, заключенные на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в тенге)
price_rur	numeric(16, 5)	Цена Фьючерса (в тенге)
ext_id_b	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Покупателем
ext_id_s	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Продавцом
date_clr	date	Дата проведения клиринга
repo_id	numeric(11)	Не используется
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в тенге)
vat_ex_b	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Покупателем (в тенге)
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в тенге)
vat_cc_b	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Покупателем (в тенге)
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в тенге)
vat_ex_s	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Продавцом (в тенге)
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в тенге)
vat_cc_s	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в тенге)

II. Отчет о заключенных Опционах

Имя файла - o04_XXY.dbf

Название поля	Тип поля	Описание поля
id_deal	numeric(10)	Идентификационный номер записи Реестра сделок
isin	char(25)	Код (обозначение) Опциона
price	numeric(16,5)	Цена Опциона (в пунктах)
vol	numeric(10)	Количество заключенных Опционов (в штуках)
kod_sell	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Продавцом
kod_buy	char(7)	Код раздела регистра учета позиций, указанный в Заявке, поданной Покупателем
date	char(10)	Дата регистрации Опционов (в формате YYYY/MM/DD)
time	char(8)	Время регистрации Опционов
profit_usd	numeric(20,4)	Не используется
type	numeric(1)	Признак: 0 – Опционы, заключенные на основании безадресной Заявки, 2 – Опционы, заключенные на основании адресной Заявки, 3 - Опционы, обязательства по которым возникли в ходе проведения процедуры принудительного закрытия позиций. 4 – снятие Опциона с учета с раздела регистра учета позиций, права по которому не востребованы Держателем.

user_buy	char(20)	Имя Продавца
user_sell	char(20)	Имя Покупателя
no_buy	numeric(10)	Идентификационный номер Заявки, поданной Покупателем, на основании которой заключены Опционы
no_sell	numeric(10)	Идентификационный номер Заявки, поданной Продавцом, на основании которой заключены Опционы
fee_buy	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Покупателем (в тенге)
fee_sell	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащая уплате Продавцом (в тенге)
date2	date	Дата регистрации Опционов
comm_buy	char(20)	Комментарий в Заявке, поданной Покупателем
comm_sell	char(20)	Комментарий в Заявке, поданной Продавцом
du_buy	numeric(1)	Всегда 0
du_sell	numeric(1)	Всегда 0
fee_ns_b	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Опционы, заключенные на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Покупателем (в тенге)
fee_ns_s	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Опционы, заключенные на основании адресной Заявки, подлежащая уплате Продавцом (в тенге)
prem_buy	numeric(16,2)	Обязательства Покупателя по уплате Премий по Опционам (в тенге)
prem_sell	numeric(16,2)	Требования Продавца по уплате Премий по Опционам (в тенге)
price_rur	numeric(16,5)	Цена Опциона (в тенге)
ext_id_b	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Покупателем
ext_id_s	numeric(11)	Дополнительный идентификационный номер, указанный в заявке, поданной Продавцом
date_clr	date	Дата проведения клиринга
var_marg_b	numeric(16,5)	Всегда 0
var_marg_s	numeric(16,5)	Всегда 0
fee_ex_b	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Покупателем (в тенге)
vat_ex_b	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Покупателем (в тенге)
fee_cc_b	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащее уплате Покупателем (в тенге)
vat_cc_b	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Покупателем (в тенге)
fee_ex_s	numeric(16,2)	Биржевой сбор, подлежащий уплате Продавцом (в тенге)
vat_ex_s	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе биржевого сбора, подлежащего уплате Продавцом (в тенге)
fee_cc_s	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в тенге)
vat_cc_s	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Продавцом (в тенге)

III. Отчет об итогах Торгов Фьючерсами

Имя файла - f07.dbf

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения Торгов (в формате YYYY/MM/DD)
contract	char(25)	Код (обозначение) Фьючерса

execution	char(10)	Дата исполнения Фьючерса (в формате YYYY/MM/DD)
volume	numeric(10)	Количество заключенных Фьючерсов (в штуках)
vol_rubl	numeric(17,2)	Объем обязательств по заключенным Фьючерсам (в тенге)
low	numeric(16,5)	Минимальная цена Фьючерсов (в пунктах)
high	numeric(16,5)	Максимальная цена Фьючерсов (в пунктах)
open	numeric(16,5)	Цена открытия (в пунктах)
close	numeric(16,5)	Цена закрытия (в пунктах)
settl	numeric(16,5)	Расчетная цена Фьючерса, определенная в ходе вечерней клиринговой сессии (в пунктах)
trades	numeric(10)	Количество внесенных в Реестр сделок записей о заключенных Фьючерсах
interest	numeric(10)	Количество Фьючерсов, обязательства по которым не прекращены (в штуках)
fee	numeric(16,5)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за один Фьючерс (в тенге)
tick_price	numeric(16,5)	Стоимость шага цены Фьючерса, установленная в Торговой системе (в тенге)
tick	numeric(16,5)	Минимальный шаг цены Фьючерса, установленный в Торговой системе (в пунктах)
avrg	numeric(16,5)	Средневзвешенная цена Фьючерса (в пунктах)
poses_rubl	numeric(17,2)	Объем непрекращенных обязательств по Фьючерсам (в тенге)
limit	numeric(16,5)	Ставка начальной маржи по Основному (ближнему) Фьючерсу (в пунктах)
kof	numeric(10,6)	Коэффициент, используемый для определения Ставки начальной маржи по Фьючерсу в зависимости от Ставки начальной маржи, установленной по Основному Фьючерсу
risk_wr	numeric(16,5)	Величина, характеризующая дополнительный риск по Опционам на продажу, базовым активом которых является Фьючерс с данным кодом (обозначением) (в тенге)
coffout	numeric(7,5)	Краевой коэффициент, установленный для Опционов, базовым активом которых является Фьючерс с данным кодом (обозначением)
base_fut	char(25)	Код базового актива Фьючерса
is_spread	numeric(1)	Признак вхождения Фьючерса в Спредовую группу: 1 – Фьючерс входит в Спредовую группу, 0 – Фьючерс не входит в Спредовую группу.
name	char(25)	Наименование Фьючерса
date2	date	Дата проведения Торгов
execution2	date	Дата исполнения Фьючерсов
deposit	numeric(16, 5)	Ставка Начальной маржи по Фьючерсу (в тенге)
is_percent	numeric(1)	Всегда 0
perc_rate	numeric(7,2)	Всегда 0
settl_rur	numeric(16, 5)	Расчетная цена Фьючерса, определенная в ходе вечерней клиринговой сессии (в тенге)
lot_volume	numeric(10)	Лот
tick_pr_go	numeric(16, 5)	Стоимость шага цены Фьючерса для расчета Начальной маржи, установленная в Торговой системе (в тенге)
limit_l1	numeric(16, 5)	Не используется
pr_settl	numeric(16, 5)	Расчетная цена Фьючерса, определенная в ходе дневной клиринговой сессии (пункты)
pr_settl_r	numeric(16, 5)	Расчетная цена Фьючерса, определенная в ходе дневной клиринговой сессии (в тенге)
type_exec	numeric(1)	Тип Фьючерса: 1- поставочный; 0 – расчетный
section	char(50)	Код Секции срочного рынка
spot	char(50)	Не используется
base	char(50)	Не используется
type_sbor	char(50)	Способ расчета биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за один Фьючерс, указанных в полях «fee» и «ns_fee»: KZT – в тенге за один Фьючерс; PERCENT – в % от цены Фьючерса

ns_volume	numeric(10)	Количество Фьючерсов, заключенных на основании адресных Заявок (в штуках)
ns_trades	numeric(10)	Количество внесенных в Реестр сделок записей о Фьючерсах, заключенных на основании адресных Заявок
ns_fee	numeric(16,5)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за один Фьючерс, заключенный на основании адресной Заявки (в тенге)
ns_volrubl	numeric(16,5)	Объем обязательств по Фьючерсам, заключенным на основании адресных Заявок (в тенге)
l_tradeday	date	Дата последнего Торгового дня, в ходе которого может быть заключен Фьючерс с данным кодом (обозначением)

IV. Отчет об итогах Торгов Опционами

Структура файла - o07.dbf

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	char(10)	Дата проведения Торгов (в формате YYYY/MM/DD)
contract	char(25)	Код (обозначение) Опциона
execution	char(10)	Дата окончания Срока действия Опциона (в формате YYYY/MM/DD)
volume	numeric(10)	Количество заключенных Опционов (в штуках)
vol_rubl	numeric(16,2)	Объем обязательств по заключенным Опционам (в тенге)
low	numeric(16,5)	Минимальная цена Опционов (в пунктах)
high	numeric(16,5)	Максимальная цена Опционов (в пунктах)
open	numeric(16,5)	Цена открытия (в пунктах)
close	numeric(16,5)	Цена закрытия (в пунктах)
avrg	numeric(16,5)	Средневзвешенная цена Опционов (в пунктах)
trades	numeric(10)	Количество внесенных в Реестр сделок записей о заключенных Опционах
interest	numeric(10)	Количество Опционов, обязательства по которым не прекращены (в штуках)
fee	numeric(16,5)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за один Опцион (в тенге)
tick_price	numeric(16,5)	Стоимость шага цены Опциона, установленная в Торговой системе (в тенге)
tick	numeric(16,5)	Минимальный шаг цены Опциона, установленный в Торговой системе (в пунктах)
poses_rubl	numeric(17,2)	Объем непрекращенных обязательств по Опционам (в тенге)
depo_uncov	numeric(16,5)	Начальная маржа по Опциону (по непокрытой позиции) (в тенге)
depo_cov	numeric(16,5)	Начальная маржа по Опциону и Фьючерсу, являющемуся базовым активом Опциона (по синтетической позиции) (в тенге)
fut_contr	char(25)	Код (обозначение) Фьючерса, являющегося базовым активом Опциона
strike	numeric(16,5)	Цена исполнения Опциона (страйк) (в пунктах)
put	char(1)	Тип опциона PUT('P') или CALL('C')
evrop	char(1)	Категория Опциона: 'E' – европейский; 'A' – американский
date2	date	Дата проведения Торгов
execution2	date	Дата окончания Срока действия Опциона
name	char(25)	Наименование Опциона
close_time	char(8)	Время, до которого могут заключаться Опционы в дату окончания Срока действия Опциона
volat	numeric(16, 5)	Волатильность Опциона, определенная в ходе вечерней клиринговой сессии
theorprice	numeric(16, 5)	Теоретическая цена Опциона, определенная в ходе вечерней клиринговой сессии (в пунктах)

tick_pr_go	numeric(16, 5)	Стоимость шага цены Опциона для расчета Начальной маржи, установленная в Торговой системе (в тенге)
pr_volat	numeric(16, 5)	Волатильность Опциона, определенная в ходе дневной клиринговой сессии
pr_theopr	numeric(16, 5)	Теоретическая цена Опциона, определенная в ходе дневной клиринговой сессии (в пунктах)
fut_type	char(1)	Всегда 0
basegobuy	numeric(16,2)	Всегда 0

V. Отчет об обязательствах по Фьючерсам

Имя файла - **fposXXYY.dbf**

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код раздела регистра учета позиций
account	char(2)	Признак раздела регистра учета позиций: 'RF' – Основной раздел; 'BF' –Группа объединенных разделов; 'CL' – Дополнительный раздел
isin	char(25)	Код (обозначение) Фьючерса
pos_beg	numeric(11)	Количество Фьючерсов, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в штуках)
pos_end	numeric(11)	Количество Фьючерсов, обязательства по которым не прекращены на конец отчетного дня (в штуках)
var_marg_p	numeric(16,2)	Вариационная маржа по Фьючерсам, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в тенге)
var_marg_d	numeric(16,2)	Вариационная маржа по Фьючерсам, заключенным в течение отчетного дня (в тенге)
sbor	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра по Фьючерсам, заключенным в течение отчетного дня (в тенге)
go_netto	numeric(16,2)	Не используется
go_brutto	numeric(16,2)	Начальная маржа, рассчитанная по брутто-принципу (в тенге)
pos_exec	numeric(11)	Количество исполненных Фьючерсов (больше нуля – исполняется продажа; меньше нуля - покупка)
du	numeric(1)	Всегда 0
sbor_exec	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение Фьючерсов (в тенге)
sbor_nosys	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Фьючерсы, заключенные в течение отчетного дня на основании адресных Заявок (в тенге)
fee_exec	numeric(16,2)	Пени за просрочку исполнения Фьючерсов (в тенге)
fine_exec	numeric(16,2)	Штраф за неисполнение Фьючерсов (в тенге)
accum_go	numeric(16,2)	Всегда 0
fee_trans	numeric(16,2)	Всегда 0
sbor_ex	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора по Фьючерсам, заключенным в течение отчетного дня (в тенге)
vat_ex	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе биржевого сбора (в тенге)
sbor_cc	numeric(16,2)	Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра по Фьючерсам, заключенным в течение отчетного дня (в тенге)
vat_cc	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра (в тенге)

VI. Отчет об обязательствах по Опционам

Имя файла - **oposXXYY.dbf**

Название поля	Тип поля	Описание поля
---------------	----------	---------------

date	date	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код раздела регистра учета позиций
account	char(2)	Признак раздела регистра учета позиций: 'RF' – Основной раздел; 'BF' –Группа объединенных разделов; 'CL' – Дополнительный раздел
isin	char(25)	Код (обозначение) Опциона
pos_beg	numeric(11)	Количество Опционов, обязательства по которым не прекращены на начало отчетного дня (в штуках)
pos_end	numeric(11)	Количество Опционов, обязательства по которым не прекращены на конец отчетного дня (в штуках)
prem	numeric(16,2)	Сумма Премий по Опционам, заключенным в течение отчетного дня (в тенге)
sbor	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра по Опционам, заключенным в течение отчетного дня (в тенге)
go	numeric(16,2)	Начальная маржа, рассчитанная по брутто-принципу (в тенге)
pos_exec	numeric(11)	Количество исполненных Опционов (больше нуля – Опционов на продажу; меньше нуля – Опционов на покупку)
pos_endcir	numeric(11)	Количество Опционов, снятых с учета с раздела регистра учета позиций в следствие истечения Срока действия Опционов, права по которым не востребованы Держателями (больше нуля – Опционов на продажу; меньше нуля – Опционов на покупку)
du	numeric(1)	Всегда 0
sbor_exec	numeric(16,2)	Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за исполнение Опционов (в тенге)
sbor_nosys	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Опционы, заключенные в течение отчетного дня на основании адресных Заявок (в тенге)
var_marg_p	numeric(16,2)	Всегда 0
var_marg_d	numeric(16,2)	Всегда 0
sbor_ex	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора по Опционам, заключенным в течение отчетного дня (в тенге)
vat_ex	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе биржевого сбора (в тенге)
sbor_cc	numeric(16,2)	Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра по Опционам, заключенным в течение отчетного дня (в тенге)
vat_cc	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра (в тенге)

VII. Отчет об обязательствах по перечислению денежных средств

Имя файла - monXXYY.dbf

Название поля	Тип поля	Описание поля
date	date	Дата проведения клиринга
kod	char(7)	Код раздела денежного регистра
account	char(2)	Признак раздела денежного регистра: 'RF' – Основной раздел; 'BF' –Группа объединенных разделов; 'CL' – Дополнительный раздел
type	char(2)	Всегда 'MN'
amount_beg	numeric(16,2)	Значение раздела денежного регистра на начало отчетного дня (в тенге)
var_marg	numeric(16,2)	Сумма Вариационной маржи по разделу денежного регистра (в тенге)
prem	numeric(16,2)	Сумма Премий по Опционам по разделу денежного регистра (в тенге)

pay	numeric(16,2)	Изменение значения раздела денежного регистра в течение дня (в тенге)
fut_sbor	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Фьючерсы (в тенге)
opt_sbor	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за Опционы (в тенге)
go	numeric(16,2)	Начальная маржа (в тенге)
amount_end	numeric(16,2)	Значение раздела денежного регистра на конец отчетного дня (в тенге)
free	numeric(16,2)	amount_end – go
du	numeric(1)	Всегда 0
gowide	numeric(16,2)	Не используется
freewide	numeric(16,2)	Не используется
margincall	char(1)	Признак наличия Маржинального требования: ' ' - Маржинальное требование отсутствует, иначе – Маржинальное требование выставлено
sbor_ex	numeric(16,2)	Сумма биржевого сбора (в тенге)
vat_ex	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе биржевого сбора (в тенге)
sbor_cc	numeric(16,2)	Сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра (в тенге)
vat_cc	numeric(16,2)	Сумма НДС в составе комиссионного вознаграждения Клирингового центра (в тенге)